

基金管理人:大成基金管理有限公司  
基金托管人:中国光大银行股份有限公司  
送出日期:2013年8月29日

# 大成货币市场证券投资基金

## 2013 年度报告摘要

差分析及相应交易情形的分析结果表明,债券交易同向交易效率较低;股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素,如个股价格振幅较高、组合经理对时点选择,因投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大。结合交易效率分布统计分析和潜在利益输送金额统计表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

基金经理在承销新股时会根据基金合同规定,于2013年8月26日复核了本报告书的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金经理的过往业绩并不代表其未来表现。投资者作出投资决策前应认真阅读本基金的招募说明书及定期报告。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月01日起至06月30日止。

### § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事声明本基金报告期内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同规定,于2013年8月26日复核了本报告书的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理在承销新股时会根据基金合同规定,于2013年8月26日复核了本报告书的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金经理的过往业绩并不代表其未来表现。投资者作出投资决策前应认真阅读本基金的招募说明书及定期报告。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月01日起至06月30日止。

### § 2 基金简介

基金简称 大成货币

基金主代码 099005

交易代码 099005

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2005年6月3日

基金管理人 大成基金管理有限公司

基金托管人 中国光大银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 11,110,545,586.39份

基金合同存续期 不定期

下属分级基金的基金简称: 大成货币A 大成货币B

下属分级基金的交易代码: 099005 091005

报告期末下属分级基金的份额总额 674,726,222.88份 10,435,819,363.51份

### § 2.1 基金基本情况

基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 大成基金管理有限公司 中国光大银行股份有限公司

姓名 王立平

信息披露负责人 联系电话 0755-81338888

电子邮箱 dclpnew@efund.com.cn

客户服务电话 4008885558

传真 0755-8199588

010-6369132

### § 2.2 基金产品说明

投资目标 在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。

投资策略 本基金通过平均剩余期限决策、类属配置和品种选择三个层次进行投资管理,以实现超越基准值的投资目标。

业绩比较基准 涨后活期存款利率

风险收益特征 本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种;预期收益和风险均低于货币基金、混合基金、股票基金。

### § 2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 大成基金管理有限公司 中国光大银行股份有限公司

姓名 王立平

信息披露负责人 联系电话 0755-81338888

电子邮箱 dclpnew@efund.com.cn

客户服务电话 4008885558

传真 0755-8199588

010-6369132

### § 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址: <http://www.efund.com.cn>

深证市辖区坂田街道大运路7088号招银银行大厦32层大成基金管理有限公司/北京市朝阳区大望桥东大街8号中国光大中心B座801中国光大银行投资与托管业务部

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

基金级别 大成货币A 大成货币B

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日) 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)

本期已实现收益 23,712,802.27 85,967,921.21

本期利润 23,712,802.27 85,967,921.21

本期净收益收益率 1.6742% 1.7967%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末基金资产净值 674,726,222.88 10,435,819,363.51

期末基金货币净值 1,0000 1,0000

注:1.本基金管理费每日基金收益公告,以每万份基金单位每日净收益为基准,为投资人每日计算收益并分配,每月集中支付一次。

2.本基金本期收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利息本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.本基金货币净值是指基金资产净值扣除当日发生的申购赎回款后的余额。

3.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成货币A

阶段 份额净值增长率(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 0.2481% 0.0032% 0.0288% 0.0000% 0.2193% 0.0032%

过去三个月 0.7890% 0.0044% 0.0873% 0.0000% 0.7017% 0.0044%

过去六个月 1.6742% 0.0044% 0.1736% 0.0000% 1.5006% 0.0044%

过去一年 3.3965% 0.0035% 0.3502% 0.0000% 3.0463% 0.0035%

过去三年 10.3987% 0.0044% 1.2437% 0.0002% 9.1550% 0.0042%

自基金合同生效起至今 24.3576% 0.0065% 9.5053% 0.0030% 14.8523% 0.0035%

注:1.本基金合同规定,本基金每日收入的基金资产净值,即为基金资产净值扣除当日发生的申购赎回款后的余额。

2.本基金的业绩基准指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利息本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.本基金货币净值是指基金资产净值扣除当日发生的申购赎回款后的余额。

3.2 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成货币A

阶段 份额净值增长率(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 0.2681% 0.0033% 0.0288% 0.0000% 0.2393% 0.0033%

过去三个月 0.8497% 0.0044% 0.0873% 0.0000% 0.7624% 0.0044%

过去六个月 1.7967% 0.0044% 0.1736% 0.0000% 1.6231% 0.0044%

过去一年 3.6449% 0.0035% 0.3502% 0.0000% 3.2947% 0.0035%

过去三年 11.1964% 0.0044% 1.2437% 0.0002% 9.9527% 0.0042%

自基金合同生效起至今 26.7982% 0.0065% 9.5053% 0.0030% 17.2929% 0.0035%

注:1.本基金合同规定,本基金每日收入的基金资产净值,即为基金资产净值扣除当日发生的申购赎回款后的余额。

2.本基金的业绩基准指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利息本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.本基金货币净值是指基金资产净值扣除当日发生的申购赎回款后的余额。

3.3 半年度报告附录

3.3.1 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

基金级别 大成货币A 大成货币B

3.3.1.1 期间数据和指标 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日) 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)

本期已实现收益 23,712,802.27 85,967,921.21

本期利润 23,712,802.27 85,967,921.21

本期净收益收益率 1.6742% 1.7967%

3.3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末基金资产净值 674,726,222.88 10,435,819,363.51

期末基金货币净值 1,0000 1,0000

注:1.本基金管理费每日基金收益公告,以每万份基金单位每日净收益为基准,为投资人每日计算收益并分配,每月集中支付一次。

2.本基金本期收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利息本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.本基金货币净值是指基金资产净值扣除当日发生的申购赎回款后的余额。

3.3.2 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成货币A

阶段 份额净值增长率(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 0.2481% 0.0032% 0.0288% 0.0000% 0.2193% 0.0032%

过去三个月 0.7890% 0.0044% 0.0873% 0.0000% 0.7017% 0.0044%

过去六个月 1.6742% 0.0044% 0.1736% 0.0000% 1.5006% 0.0044%

过去一年 3.3965% 0.0035% 0.3502% 0.0000% 3.0463% 0.0035%

过去三年 10.3987% 0.0044% 1.2437% 0.0002% 9.1550% 0.0042%

自基金合同生效起至今 24.3576% 0.0065% 9.5053% 0.0030% 17.2929% 0.0035%

注:1.本基金合同规定,本基金每日收入的基金资产净值,即为基金资产净值扣除当日发生的申购赎回款后的余额。

2.本基金的业绩基准指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利息本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.本基金货币净值是指基金资产净值扣除当日发生的申购赎回款后的余额。

3.3.3 半年度报告附录

3.3.3.1 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

基金级别 大成货币A 大成货币B

3.3.3.1.1 期间数据和指标 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日) 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)

本期已实现收益 23,712,802.27 85,967